

## 国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金

## [2014]第三季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。  
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2014年10月23日对本基金的报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，进行了复核，确认不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。  
基金的过往业绩并不代表未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称		
国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金		
场内简称		
国泰地产		
基金代码		
660238		
基金托管方式		
银行托管		
基金合同生效日		
2013年2月6日		
报告期末基金份额总额		
560,302,929.10份		
投资目标		
紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。		
1. 股权投资策略		
本基金将主要通过全股票型基金投资于具有较高股息率且行业地位突出的公司股票，同时通过股票型基金、债券型基金、货币市场基金等其他金融工具进行风险对冲操作。股票型基金投资比例不低于基金资产的80%，债券型基金投资比例不超过基金资产的20%，货币市场基金投资比例不超过基金资产的5%。		
2. 债券投资策略		
本基金将主要通过债券型基金投资于具有较高股息率且行业地位突出的公司债券，同时通过股票型基金、货币市场基金等其他金融工具进行风险对冲操作。债券型基金投资比例不低于基金资产的80%，股票型基金投资比例不超过基金资产的20%，货币市场基金投资比例不超过基金资产的5%。		
3. 货币市场投资策略		
本基金将主要通过货币市场基金投资于具有较高股息率且行业地位突出的公司货币市场基金，同时通过股票型基金、债券型基金等其他金融工具进行风险对冲操作。货币市场基金投资比例不低于基金资产的80%，股票型基金投资比例不超过基金资产的20%，债券型基金投资比例不超过基金资产的5%。		
4. 期权投资策略		
本基金将主要通过股票型基金投资于具有较高股息率且行业地位突出的公司股票，同时通过股票型基金、货币市场基金等其他金融工具进行风险对冲操作。股票型基金投资比例不低于基金资产的80%，货币市场基金投资比例不超过基金资产的20%。		
5. 买入返售金融资产		
本基金将主要通过买入返售金融资产投资于具有较高股息率且行业地位突出的公司金融产品，同时通过股票型基金、货币市场基金等其他金融工具进行风险对冲操作。买入返售金融资产投资比例不超过基金资产的5%。		
6. 银行存款和结算备付金合计		
48,702,670.97		
7. 其他资产		
476,758.00		
8. 合计		
595,078,152.00		

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金报告期末未持有按行业分类的股票投资。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金报告期末未持有按行业分类的股票投资。

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期: (2014年7月1日-2014年9月30日)

1.本期已实现收益 27,382,901.95

2.本期利润 127,288,874.43

3.期末基金资产净值 593,648,924.41

4.期末基金份额净值 1.00

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(2)所述本期业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于不计手续费的收益。

5.3.1报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1.1报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1.2报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.3报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.4报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.5报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.6报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.7报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.8报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.9报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.10报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.11报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.12报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.13报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.14报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.15报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.16报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.17报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.18报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.19报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.20报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.21报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.22报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.23报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.24报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.25报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.26报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.27报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.28报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.29报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.30报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.31报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.32报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.33报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.34报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.35报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.36报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.37报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.38报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.39报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.40报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.41报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.42报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.43报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.44报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.45报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.46报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.47报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.48报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.49报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.50报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.51报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.52报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.53报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.54报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.55报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.56报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.57报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.58报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.59报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.60报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.61报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.62报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.63报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.64报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.65报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.66报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.67报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.68报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.69报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.70报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.71报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.72报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.73报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.74报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.75报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.76报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.77报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.78报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.79报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

5.3.1.80报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.3.1.81报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名衍生工具投资明细

5.3.1.82报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

5.3.1.83报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.3.1.84报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细